Santander

BANCO SANTANDER S.A.

LISTADO DE INSTRUMENTOS INTERNALIZADOR SISTEMÁTICO

Santander

1. INSTRUMENTOS FINANCIEROS

1.1 Régimen obligatorio

Banco Santander, S.A. (Código MIC SANT) es “Internalizador Sistemático” de acuerdo con el artículo 4(1)(20) de MiFID II (Directiva 2014/65/UE del Parlamento Europeo y del Consejo, de 15 de mayo de 2014 , relativa a los mercados de instrumentos financieros y por la que se modifican la Directiva 2002/92/CE y la Directiva 2011/61/UE) para los siguientes instrumentos financieros a partir del 15 de Febrero de 2023:

1.1.1 Bonos (todos los tipos de bonos excepto materias primas cotizadas (ETCs), pagarés cotizados (ETNs)

a. Bonos Soberanos

Issuer LEI	Issuer	Legal Jurisdiction
549300KPBYGYF7HCHO27	The Republic of Argentina	AR
254900ZFY40OYEADAP90	Federative Republic of Brazil	BR
549300FLZTJM5YJF8D34	Republic of Chile	CL
549300MHDRBVRF6B9117	Republic of Colombia	CO
ECTRVYYCEF89VWYS6K36	Her Majesty's Treasury	UK
254900EGTWEU67VP6075	United Mexican States	MX
254900STKLK2DBJJZ530	Republica del Peru	PE
259400R9L8QEP0TPXS31	REPUBLIC OF POLAND-MINISTRY OF POLAND	PL
529900UXKJTJPCU0HK83	República del Paraguay	PY
815600DE60799F5A9309	REPUBBLICA ITALIANA	IT
254900EHU7Q8FGVPI369	MINISTERIO DE HACIENDA DE LA REPUBLICA DOMINICANA	DO
549300SU25TO8EMXB434	Empresas Públicas de Medellin E.S.P.	CO
9598007A56S18711AH60	SECRETARÍA GENERAL DEL TESORO Y FINANCIACIÓN INTERNACIONAL	ES
549300SHS4T08CL0LP14	Ministry of Economy and Finance of the Republic of Panama	PA
254900HROIFWPRGM1V77	United States Department of the Treasury	US
549300W13SXC7EKNJC20	The Commonwealth of The Bahamas	BS

a. Bonos Corporativos

Issuer LEI	Issuer	Legal Jurisdiction
5493000J801JZRCMFE49	PETROLEO BRASILEIRO S A PETROBRAS	BR
254900IDGKCJICKBPA66	ECOPETROL S.A.	CL
5493006QMFDDMYWIAM13	Banco Santander S.A.	ES
549300CAZKPF4HKMPX17	Petróleos Mexicanos	MX
724500PBR8LR26XBSP67	EMBRAER NETHERLANDS FINANCE BV	NL
549300SMVCQN2P0O6I58	SANTANDER HOLDINGS USA INC	US
SCRYQ25DTVRHYYMM6P89	BANCO SANTANDER MEXICO S.A. INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE GRUPO FINANC	MX
549300B56MD0ZC402L06	BLOOMBERG L P NEW YORK	US
549300YM5CWCAUVOPB53	ENEL CHILE S.A.	CL

Santander

254900287ZNSGVP1R341	Suzano Austria GmbH	AT
222100R8R68DM7VM3661	CSN INOVA VENTURES	KY
2549000TLMHFQ74DS330	Braskem Netherlands Finance B.V.	NL
R0MUWSFPU8MPRO8K5P83	BNP PARIBAS	FR
549300SZJ9VS8SGXAN81	UBS Group AG	CH
529900NNUPAGGOMPXZ31	VOLKSWAGEN AKTIENGESELLSCHAFT	DE
ES7IP3U3RHIGC71XBU11	Royal Bank of Canada	CA
BFM8T61CT2L1QCEMIK50	UBS AG	CH
95980020140005919311	FUNDACIÓN BANCARIA CAIXA D'ESTALVIS I PENSIONS DE BARCELONA, "LA CAIXA"	ES
549300SZYINBBLJQU475	AerCap Holdings N.V.	IR
254900BA3U6G5DNV5V04	Vale Overseas Limited	BR
5493009981WBHS86CJ89	St. Marys Cement Inc. (Canada)	CA
549300DT8SH0CF6BTT37	The Central America Bottling Corporation	VG
254900A71Y7WHN7L5K89	INVESTMENT ENERGY RESOURCES LIMITED	BM
222100ZEX458NMOXZP08	CSN RESOURCES S.A.	LU
54930074AZRQQPMINM11	Natura &Co Luxembourg Holdings S.à r.l.	LU
549300QTVYRPFHS0J362	BANCO MERCANTIL DEL NORTE SA INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE GRUPO FINANCIERO BANORTE	MX
549300YP3P0JZBLIV197	Empresa Nacional del Petróleo	CH
549300JJJIQXE6E1QY27	GNL Quintero S.A.	CH
254900IXHTV7LDSFQD65	Promigas S.A. E.S.P.	CO

1.1.2 Derivados

Banco Santander, S.A. (Código MIC SANT) es “Internalizador Sistemático” de acuerdo con el artículo 4(1)(20) de MiFID II para Derivados sobre Divisas a partir del 15 de Febrero de 2023, para:

- algunos pares de divisas y periodos en los productos: Opciones sobre divisas, Contratos a plazo entregables, Swaps de divisas entregables, Contratos a plazo no entregables y Opciones sobre divisas no entregables.

1.2 Régimen voluntario

Banco Santander S.A. de forma voluntaria será Internalizador Sistemático en los siguientes instrumentos financieros:

1.2.1 Derivados sobre Divisas:

- FX swap: todas las divisas y todos los periodos.
- Swaps no entregables: todas las divisas y todos los periodos.
- Contratos a plazo no entregables (NDF): todas las divisas y todos los periodos.
- Contratos a plazo entregables (DF): todas las divisas y todos los periodos.
- Opciones sobre divisas no entregables (NDO): todas las divisas y todos los periodos.

- Opciones sobre divisas entregables (DO): todas las divisas y todos los periodos.
- Otros derivados sobre divisas: todas las divisas y todos los periodos.

1.2.2 Derivados sobre tipos de interés y swaps de divisa

a. ToTV EUR Swap

- Subclases de activos:
  - «Swaps en una sola divisa» fijo por variable y contratos de futuros/contratos a plazo sobre «swaps en una sola divisa» fijo por variable.
  - «Swaps en una sola divisa» fijo por fijo y contratos de futuros/contratos a plazo sobre «swaps en una sola divisa» fijo por fijo.
  - «Swaps en una sola divisa» variable por variable y contratos de futuros/contratos a plazo sobre «swaps en una sola divisa» variable por variable.
  - «Swaps en una sola divisa» OIS y contratos de futuros/contratos a plazo sobre «swaps en una sola divisa» OIS.
  - «Swaps en una sola divisa» de inflación y contratos de futuros/contratos a plazo sobre «swaps en una sola divisa» de inflación.
- Criterio de segmentación 1 — moneda nocional en que se expresan los dos lados de la permuta: **EUR**
- o Criterio de segmentación 2 — período de vencimiento de la permuta: **todos los periodos.**

b. ToTV GBP Swap

- Subclases de activos:
  - «Swaps en una sola divisa» fijo por variable y contratos de futuros/contratos a plazo sobre «swaps en una sola divisa» fijo por variable
  - «Swaps en una sola divisa» fijo por fijo y contratos de futuros/contratos a plazo sobre «swaps en una sola divisa» fijo por fijo
  - «Swaps en una sola divisa» variable por variable y contratos de futuros/contratos a plazo sobre «swaps en una sola divisa» variable por variable.
  - «Swaps en una sola divisa» OIS y contratos de futuros/contratos a plazo sobre «swaps en una sola divisa» OIS
  - «Swaps en una sola divisa» de inflación y contratos de futuros/contratos a plazo sobre «swaps en una sola divisa» de inflación

- Criterio de segmentación 1 — moneda nocional en que se expresan los dos lados de la permuta: **GBP**
- Criterio de segmentación 2 — período de vencimiento de la permuta: **todos los periodos.**

c. ToTV BRL Swap

- Subclases de activos:
  - «Swaps en una sola divisa» fijo por variable y contratos de futuros/contratos a plazo sobre «swaps en una sola divisa» fijo por variable
  - «Swaps en una sola divisa» OIS y contratos de futuros/contratos a plazo sobre «swaps en una sola divisa» OIS

Santander

- Criterio de segmentación 1 — moneda nocional en que se expresan los dos lados de la permuta: **BRL**
- Criterio de segmentación 2 — período de vencimiento de la permuta: **todos los periodos.**

d. ToTV MXN Swap

- Subclases de activos:
  - «Swaps en una sola divisa» fijo por variable y contratos de futuros/contratos a plazo sobre «swaps en una sola divisa» fijo por variable
  - «Swaps en una sola divisa» OIS y contratos de futuros/contratos a plazo sobre «swaps en una sola divisa» OIS

- Criterio de segmentación 1 — moneda nocional en que se expresan los dos lados de la permuta: **MXN**
- Criterio de segmentación 2 — período de vencimiento de la permuta: **todos los periodos.**

e. ToTV CLP Swap

- Subclases de activos:
  - «Swaps en una sola divisa» fijo por variable y contratos de futuros/contratos a plazo sobre «swaps en una sola divisa» fijo por variable
  - «Swaps en una sola divisa» OIS y contratos de futuros/contratos a plazo sobre «swaps en una sola divisa» OIS

- Criterio de segmentación 1 — moneda nocional en que se expresan los dos lados de la permuta: **CLP**
- Criterio de segmentación 2 — período de vencimiento de la permuta: **todos los periodos.**

f. ToTV COP Swap

- Subclases de activos:
  - «Swaps en una sola divisa» fijo por variable y contratos de futuros/contratos a plazo sobre «swaps en una sola divisa» fijo por variable
  - «Swaps en una sola divisa» OIS y contratos de futuros/contratos a plazo sobre «swaps en una sola divisa» OIS

- Criterio de segmentación 1 — moneda nocional en que se expresan los dos lados de la permuta: **COP**
- Criterio de segmentación 2 — período de vencimiento de la permuta: **todos los periodos.**

g. ToTV PLN Swap

- Subclases de activos:
  - «Swaps en una sola divisa» fijo por variable y contratos de futuros/contratos a plazo sobre «swaps en una sola divisa» fijo por variable
  - «Swaps en una sola divisa» OIS y contratos de futuros/contratos a plazo sobre «swaps en una sola divisa» OIS

Santander

- Criterio de segmentación 1 — moneda nocional en que se expresan los dos lados de la permuta: **PLN**
- Criterio de segmentación 2 — período de vencimiento de la permuta: **todos los periodos.**

h. ToTV CCS:

- Subclases de activos:
  - «Swaps multidivisa» fijo por fijo y contratos de futuros/contratos a plazo sobre «swaps multidivisa» fijo por fijo
  - «Swaps multidivisa» fijo por variable y contratos de futuros/contratos a plazo sobre «swaps multidivisa» fijo por variable
  - «Swaps multidivisa» variable por variable y contratos de futuros/contratos a plazo sobre «swaps multidivisa» variable por variable
  - «Swaps multidivisa» OIS y contratos de futuros/contratos a plazo sobre «swaps multidivisa» OIS
  - «Swaps multidivisa» de inflación y contratos de futuros/contratos a plazo sobre «swaps multidivisa» de inflación

- Criterio de segmentación 1 — par de monedas nocionales definido como combinación de las dos monedas en que se expresan los dos lados de la permuta: **todas**
- Criterio de segmentación 2 — período de vencimiento de la permuta: **todos los periodos.**

1.2.3 Bonos (todos los tipos de bonos excepto materias primas cotizadas (ETCs), pagarés cotizados (ETNs)

a. Bonos Soberanos

- Todos los bonos soberanos emitidos por España, Reino Unido y Portugal.
- Además, Banco Santander S.A. de forma voluntaria será Internalizador Sistemático de:
  - Bonos Soberanos y Otros Bonos Públicos de los siguientes emisores:

Issuer LEI	Issuer	Legal Jurisdiction
22210065LIUFB00MNF63	Grand Duchy of Luxembourg	LU
549300X0MVH42CY8Q105	Asian Development Bank	PH
VKU1UKDS9E7LYLMACP54	Inter-American Development Bank	US
ZTMSNXROF84AHWJNKQ93	International Bank for Reconstruction & Development	US
P41R60HC414IWQA1XW02	International Development Association	US
QKL54NQY28TCDAI75F60	International Finance Corp	US
0SK1ILSPWNVBNQWU0W18	Landeskreditbank Baden-Wuerttemberg Foerderbank	DE
52990002O5KK6XOGJ020	NRW.Bank	DE
635400ZZE5J8OXXBBY26	Ontario Teachers' Finance Trust	CA

Santander

C7PVKCRGLG18EBQGZV36	Province of Ontario	CA
549300WN65YFEQH74Y36	Province of Quebec	CA
549300LNCLMO3ITVCU07	African Development Bank	CI
529900D8QLTZ6PRLJL76	KommuneKredit	DK
529900HEKOENJHPNN480	Municipality Finance Plc	FI
213800HYL1S7VAXG6Z48	NORDIC INVESTMENT BANK	FI

- Sovereigns, Supranationals and Agencies ("SSA")

Issuer LEI	**Issuer**	**Legal Jurisdiction**
529900FZRK8FGMPEOM08	EUROPEAN UNION	BE
549300GDPG70E3MBBU98	KFW	DE
529900VWPV1LPOHGJ702	LAND NORDRHEIN-WESTFALEN	DE
5493006YXS1U5GIHE750	EUROPEAN INVESTMENT BANK	DE
222100OW6UHQXNHKN143	EFSF	LU
529900Z3J0N6S0F7CT25	LANDWIRTSCH. RENTENBANK	DE
969500P04DQJS4BPM574	CAISSE D'AMORT DETTE SOC	FR
969500V3L9W19NIA5E82	UNEDIC	FR
222100W4EEAQ77386N50	EURO STABILITY MECHANISM	LU
529900GGYMNGRQTDOO93	BNG BANK NV	NL
9695008K5N8MKIT4XJ91	AGENCE FRANCAISE DEVELOP	FR
969500STN7T9MRUMJ267	BPIFRANCE SACA	FR
959800KASH3LCM57Q344	COMMUNITY OF MADRID SPAI	ES
ZTMSNXROF84AHWJNKQ93	INTL BK RECON & DEVELOP	US
549300UYNXMI821WYG82	COUNCIL OF EUROPE	FR
81560029E2CE4D14F425	CASSA DEPOSITI E PRESTIT	IT
9695004RTVK8D9VA8F57	SOCIETE DU GRAND PARIS	FR
JLP5FSPH9WPSHY3NIM24	NEDERLANDSE WATERSCHAPSBANK N.V.	NL
PJQDPSI1D8J2Q1IM3G17	INSTITUT CREDITO OFICIAL	ES
959800G42HFTN7MWAY79	JUNTA DE ANDALUCIA	ES
959800SNQAKVSTR20G68	BASQUE GOVERNMENT	ES
95980020140005708045	FADE	ES
959800Y87BK35RUBP092	JUNTA DE CASTILLA Y LEON	ES
9598006NADCDHBCA0B85	XUNTA DE GALICIA	ES

Santander

P41R60HC414IWQA1XW02	International Development Association	US
549300KW9NB55HTDK075	Canada Pension Plan Investment Board	CA
HZFDOR6TCRSIQLKQTX32	FMS Wertmanagement	DE
2138008GSNH2EM5YC581	LCR FINANCE PLC	UK
213800H88F5EE4B1D697	Network Rail Infrastructure Finance	UK
969500A4MXJ3ESPHK698	Societe Nationale SNCF SA	FR
213800KYFURAB8VGOE72	STATES OF GUERNSEY TREASURY AND RESOURCES DEPARTMENT	GG
2138009E61CC6O1J9E38	States of Jersey	JE
549300ZXHSYV21BRHW71	Treasury Department of the Isle of Man Government	IM
I7ETN0QQO2AHZZGHJ389	KOMMUNALBANKEN AS	NO
1FOLRR5RWTWWI397R131	SWEDISH EXPORT CREDIT	SE

b. Bonos Corporativos

- Todos los emisores de bonos corporativos con emisiones en EUR y GBP (excepto emisores latinoamericanos y polacos).

c. Bonos Garantizados

- Todos los emisores de bonos garantizados con emisiones en EUR, USD y GBP (excepto emisores latinoamericanos y polacos).

1.2.4 Opciones sobre Tipos de Interés

a. Cap

- Todas las divisas y todos los periodos.

b. Floor

- Todas las divisas y todos los periodos.

1.2.5 Bond Forward

a. Subyacente: Bono

1.2.6 Swaptions

a. Todos los Swaptions.

1.2.7 Total Return Swap

a. Subyacente: Bono / Inflación

1.2.8 Productos de financiación estructurada (PFE)

a. Asset Backed Securities

b. Mortgage Backed Securities

2. OBLIGACIONES POSTNEGOCIACIÓN

En cumplimiento del artículo 7(6) del *Reglamento Delegado (UE) 2017/583 de la Comisión, de 14 de julio de 2016, por el que se completa el Reglamento (UE) n.° 600/2014 del Parlamento*

Europeo y del Consejo, relativo a los mercados de instrumentos financieros, en lo que respecta a las normas técnicas de regulación sobre los requisitos de transparencia aplicables a los centros de negociación y las empresas de servicios de inversión con relación a los bonos, los productos de financiación estructurada, los derechos de emisión y los derivados, le informamos de que, en aquellos casos en que Banco Santander, S.A. sea el único IS en un determinado instrumento financiero y esté actuando como comprador en una determinada transacción, cumpliremos con las obligaciones de transparencia post negociación.

3. REVISIÓN PERIÓDICA

La lista de instrumentos financieros será revisada trimestralmente cuando ESMA publique los cálculos oficiales del régimen de IS.